כללי

במסמך זה מפורטות ההגדרות של השדות המופיעים בטבלאות ני"ע לפי חתכים, סיכומים לפי חתכים ושוק הנגזרים – נכסי בסיס (לוחות 1,2,4 ו-9 לשעבר). הגדרות 1 עד 17 תקפות גם לאותם השדות ביתר הטבלאות שבמדריך הסחירות.

1. תקופת הדו"ח

בכל מקום שלא נאמר אחרת הנתונים מתייחסים לתקופת הדו"ח, נתוני שווי שוק מתייחסים ליום המסחר האחרון בתקופת הדו"ח.

2. שם נייר הערך

שם מקוצר של החברה ושל סוג נייר הערך: אין ציון = מניה, אפ = כתב אופציה,

ש"ה=שטר-הון, אא=אג"ח אופציה, אג=איגרת חוב, אר=אופצית רכישה, מ- מוסדי.

3. סימול

סימול (Symbol) נייר הערך בעברית.

4. שערי ניירות הערך

4.א. שער אחרון בתקופה - שער הנעילה ביום המסחר האחרון בתקופת הדו"ח.

4.ב. שער גבוה - שער הנעילה הגבוה שנקבע לנייר הערך במסחר בבורסה בתקופת הדו"ח, מתואם לזכויות להתאמה.

4.ג. שער נמוך - שער הנעילה הנמוך שנקבע לנייר הערך במסחר בבורסה בתקופת הדו"ח, מתואם לזכויות להתאמה.

5. תשואה

תשואת החזקה בנייר הערך, מתואמת לזכויות להתאמה, מתחילת החודש ומתחילת השנה בהתאמה.

6. שווי שוק

שווי השוק של נייר הערך, המחושב כמכפלה של ההון הרשום בשער הנעילה ביום המסחר האחרון בתקופת הדו"ח.

7. מחזור תמורה כספית

התמורה הכספית של מחזור המסחר בבורסה, ומחוצה לה בתקופת הדו"ח.

8. הון רשום

ההון המונפק והנפרע בניכוי מניות רדומות, ביום המסחר האחרון בתקופת הדו"ח.

9. מחזור יומי ממוצע

התמורה הכספית של מחזור המסחר בבורסה בתקופת הדו"ח מחולק במספר הימים בהם התקיים מסחר בנייר הערך באותה תקופה.

10. סטיית התקן של התשואה (s) (באחוזים)

מחושבת כסטיית תקן "לוג נורמלית" שבועית, בחצי השנה האחרונה שהסתיימה בסוף החודש שאליו מתייחס הדו"ח.

כאשר:

St = שער הבסיס של נייר הערך בתחילת שבוע המסחר.

St+1 = שער נעילה של נייר הערך, ביום המסחר האחרון בשבוע המסחר.

LN = הלוגריתם הטבעי.

LN = Et של התשואה השבועית.

N = מס השבועות = 26 (½ שנה).

11. מספר ימי מסחר

מספר הימים בהם נסחר נייר הערך בתקופת הדו"ח.

12. מספר ימי מחזור אפס

מספר הימים בהם לא בוצעה כל עסקה בנייר הערך.

13. מספר ימי ה"מ (הפסקת מסחר - במשך כל היום)

מספר הימים בהם היו הפסקות מסחר בנייר הערך, במשך כל היום.

14 הפסקה ממושכת

הפסקת מסחר מעל שלושה חודשים.

15. שווי שוק של חברה

שווי השוק של כל סוגי המניות וכתבי האופציה הרשומים למסחר.

16. ממוצע תת-ענפי

בלוחות המציגים רשימת ניירות ערך לפי ענפים בסוף הלוח יופיע ממוצע תת- ענפי לא משוקלל (פרט לתשואות בהן הממוצע משוקלל) של נתונים.

בסינונים של מניות והמירים ממוצע תת-ענפי יוצג לפי חלוקה הבאה:

מניות - הנתונים לכל המניות בתת-ענף.

אופציות - הנתונים לכל כתבי האופציה בתת-הענף.

אג"ח להמרה - הנתונים לכל אגרות החוב להמרה בתת הענף.

17. סימונים בגוף הדו"ח

* סימון זה מציין כי בוצע "אקס" במהלך תקופת הדו"ח.

סימון זה מציין כי נייר הערך התחיל להיסחר במהלך התקופה. התשואה במקרה כזה מחושבת ממועד תחילת המסחר ואיננה מגולמת.

טבלת סיכומים לפי חתכים מסוננת לפי מניות והמירים /חתך ראשי ו-ממוצע יומי מחזורי מסחר /חתך משני (לשעבר לוח 2 – ממוצעים ענפיים)

1. כמות ני"ע משתתפים

מספר ני"ע בקבוצה כולל ני"ע שהחלו להיסחר במהלך תקופת הדוח.

2. ממוצע התשואה

יחושב כממוצע משוקלל של תשואות כל הני"ע הנכללים בתת ענף (שקלול בשווי שוק יחסי) באופן הבא:

כאשר:

Ri = תשואת ני"ע i ב- %.

Vi = שווי שוק ני"ע

3. ממוצעים הכלל בורסאיי

בסוף הלוח מופיעים הממוצעים הכלל בורסאיים.

4. נתוני שווי שוק ומחזור ת"כ (בורסה ומחוץ לבורסה) מחושבים לכל הניירות הנסחרים בתקופת הדו"ח.

5. נתוני תשואה, מחזור יומי ממוצע וס.ת. תשואה אינם כוללים ניירות שהחלו להיסחר במהלך תקופת הדו"ח.

טבלת סיכומים לפי חתכים מסוננת לפי מניות והמירים (לשעבר לוח 4 – ניירות רצף)

1. מחזור יומי ממוצע מחוץ לבורסה (אלפי ש"ח) - התמורה הכספית, באלפי ש"ח, של העסקאות שבוצעו מחוץ לבורסה בתקופת הדו"ח, מחולק במספר הימים בהם התקיים מסחר בבורסה באותה תקופה.

2. מחזור יומי ממוצע (אלפי ש"ח) - התמורה הכספית של מחזור המסחר בנייר הערך בתקופת הדו"ח, בכל אחד משלבי המסחר ובסה"כ, מחולק במספר הימים בהם התקיים מסחר בנייר הערך (כולל ימים בהם המחזור כאמור היה אפס) באותה תקופה.

3. % מסה"כ מחזור יומי ממוצע - אחוז המחזור היומי הממוצע בכל אחד משלבי המסחר, מתוך סה"כ המחזור היומי הממוצע.

4. מספר עסקאות יומי ממוצע - מספר העסקאות שבוצעו בנייר הערך בתקופת הדו"ח, בכל אחד משלבי המסחר ובסה"כ, מחולק במספר הימים בהם התקיים מסחר בנייר הערך באותה תקופה.

5. מסה"כ מס' עסקאות יומי ממוצע - אחוז מספר העסקאות היומי הממוצע בכל אחד משלבי המסחר, מתוך סה"כ מספר העסקאות היומי הממוצע.

טבלת שוק הנגזרים (לשעבר לוח 9: מעו"ף – ריכוז חוזים עתידיים ואופציות מעו"ף)

נגזרים - שם כולל לקבוצת מכשירים פיננסיים, שערכם נגזר משווי נכס הבסיס, הכוללת בין היתר: אופציות רכש , אופציות מכר וחוזים עתידיים .

1. חתך

אופציות רכש - אופציות CALL המקנות למחזיק בהן זכות לרכוש את נכס הבסיס במחיר המימוש הנקוב באופציה, בתאריך המימוש של האופציה.

אופציות מכר - אופציות PUT המקנות למחזיק בהן זכות למכור את נכס הבסיס במחיר המימוש הנקוב באופציה, בתאריך המימוש של האופציה.

חוזים עתידיים - חוזה עתידי הוא הסכם למסירה עתידית של נכס הבסיס ע"י מוכר החוזה וקבלתו ע"י רוכש החוזה במחיר הנקוב בחוזה, המשולם במועד עתידי הקבוע בתנאי החוזה העתידי.

2. עסקאות

מספר עסקאות בתקופה - סה"כ מספר עסקאות בנגזרים שנסחרו בתקופת הדו"ח.

מספר עסקאות יומי ממוצע - סה"כ מספר העסקאות שבוצעו בנגזרים בתקופת הדו"ח, מחולק במספר ימי מסחר בתקופה.

גודל עסקה ממוצעת ביחידות - סה"כ מספר היחידות שנסחרו בנגזרים בתקופת הדו"ח מחולק בסה"כ מספר העסקאות בתקופה.

3. מחזור ממוצע

כל הנתונים המפורטים בסעיף 5 כשהם מחולקים במספר ימי המסחר בתקופת הדו"ח.

4. מספר פוזיציות

מקסימאלי יומי לתקופה - מספר הפוזיציות הפתוחות המקסימאלי שדווח למסלקת מעו"ף ביום מסוים במהלך התקופה הנבדקת (חודש או שנה).

מדי בוקר מדווחים חברי מסלקת מעו"ף על כמות הפוזיציות הפתוחות של לקוחותיהם למסלקת מעו"ף. מסלקת מעו"ף סוכמת את כמות הפוזיציות הפתוחות בנכס בסיס מסוים (למשל מדד ת"א-35) בכל חשבונות לקוחותיהם של חברי מסלקת מעו"ף. הספירה הינה רק של צד השורט לחוזה.

תאריך - התאריך שבו נרשם מספר פוזיציות מקסימלי לתקופת הדו"ח.

לסוף תקופה - מספר פוזיציות פתוחות שדווח למסלקת מעו"ף ביום המסחר האחרון בתקופה הנבדקת (חודש או שנה).

ממוצע יומי - הסכום היומי המצטבר של הפוזיציות הפתוחות שהיו בתקופת הדו"ח, מחולק במספר ימי המסחר בתקופה.

5. סה"כ מחזור בתקופה

ביחידות - סה"כ מספר הנגזרים שנסחרו בתקופת הדו"ח.

בפרמיות - מחיר האופציה בשוק נקרא "פרמיה". סה"כ מחזור בתקופה בפרמיות מבטא את סה"כ התמורה הכספית באלפי ש"ח שהחליפה ידיים בין הקונים למוכרים במסחר באופציות בתקופה הרלוונטית

במונחי נכס בסיס - מבטא את המחזור בנגזרים כשווה ערך למחזור הכספי במונחי נכס הבסיס של הפוזיציה הממונפת. הנתון מחושב בנפרד עבור כל נכס בסיס לתקופה הנבדקת (חודש או שנה) באלפי ש"ח.

מחזור במונחי נכס בסיס ליום נתון מחושב באופן הבא:

מחיר נכס הבסיס הקובע ביום נתון

X

מחזור יומי ביחידות בכל הנגזרים על נכס בסיס ספציפי ביום נתון

X

מכפיל נכס הבסיס של הנגזר

=

מחזור במונחי נכס בסיס ליום נתון

6. פוזיציות פתוחות לתקופה במונחי נכס בסיס

שווי מקסימלי לתקופה - "שווי הפוזיציות הפתוחות במונחי נכס בסיס" מבטא את כמות הפוזיציות הפתוחות כשווה ערך כספי במונחי נכס הבסיס של הפוזיציה הממונפת באלפי ש"ח. "שווי הפוזיציות הפתוחות במונחי נכס בסיס מקסימאלי לתקופה" מחושב כמקסימום של המכפלה הבאה, בתקופת הדו"ח:

מחיר נכס הבסיס הקובע ביום נתון

X

מספר פוזיציות פתוחות ביום נתון

X

מכפיל נכס הבסיס של הנגזר

תאריך - התאריך בו נרשם שווי מקסימלי של פוזיציות פתוחות במונחי נכס בסיס, בתקופת הדו"ח.

7. נתונים נוספים

מספר חשבונות מקסימאלי יומי לתקופה - מדי בוקר מדווחים חברי מסלקת מעו"ף את פרטי הפוזיציות של לקוחותיהם למסלקת מעו"ף. מסלקת מעו"ף סוכמת את מספר החשבונות בנכס בסיס מסוים (למשל מדד ת"א-35).

מספר חשבונות מקסימאלי לתקופה הינו מספר החשבונות המקסימאלי שדווח למסלקת מעו"ף ביום מסוים במהלך התקופה הנבדקת (חודש או שנה).

תאריך - התאריך בו נרשם מספר החשבונות המקסימלי היומי בתקופה.

לסוף תקופה - מספר חשבונות שדווחו למסלקת מעו"ף ביום המסחר האחרון בתקופה.

מחזור בנכס בסיס - סך המחזור במניות המדד או נייר ערך המהווה נכס בסיס במהלך תקופת הדו"ח, באלפי ש"ח.

מחזור ממוצע במונחי נכס בסיס משוקלל דלתא - סה"כ המחזור במונחי נכס בסיס משוקלל דלתא (ראה סעיף הבא) כשהוא מחולק במספר ימי מסחר בתקופת הדו"ח.

סה"כ מחזור בתקופה במונחי נכס בסיס משוקלל דלתא - מחזור במונחי נכס בסיס משוקלל דלתא של כלל נגזרים שנסחרו מדי יום על פני התקופה הנבדקת (חודש/ שנה). מחזור במונחי נכס בסיס של אופציה מסויימת משוקלל בדלתא של אותה אופציה ליום מסויים יחושב באופן הבא:

המחזור היומי באופציה ספציפית

X

מכפיל נכס הבסיס של האופציה

X

הדלתא של האופציה

X

מחיר נכס הבסיס ביום הנבדק

יחס מחזור - נתון זה מחושב כיחס בין סך המחזור במונחי נכס בסיס משוקלל דלתא במהלך התקופה הנבדקת לסך המחזור בנכס בסיס רלוונטי באותה תקופה (חודש או שנה).